南方東英 WTI 原油年度滾動十二月期貨 ER ETF

股份代號：3135

所有資料截至2017年12月31日

重要事項：投資涉及風險。投資價格可升可跌。所呈列的往績資料並不表示將來亦會有類似的業績。投資者應詳細閱讀有關章程及產品資料概要（包括所載之產品特色及風險因素）。投資者不應僅憑本文件作出投資決定。如果你對有關章程及產品資料概要內容有任何疑問，應諮詢你的股票經紀，銀行經理，律師，會計師或其他財務顧問以取得獨立財務意見。

- 南方東英WTI原油年度滾動十二月期貨ER ETF（「子基金」）是一項以期貨為基礎的交易所買賣基金。子基金旨在提供於扣除費用及開支之前與美銀美林商品指數eXtra CLA指數（額外回報）（“額外回報”並不代表此交易所買賣基金的表現會有任何額外的回報））（「指數」）表現非常接近之投資回報。
- 子基金將直接投資於在紐約商品交易所（「紐約商交所」）買賣的十二月份的西德克薩斯中質原油（「WTI」）期貨合約。子基金的投資只適合具備可以承擔期貨投資所涉風險的財務狀況的投資者。
- 期貨投資須承受若干主要風險，包括槓桿、交易對手及流動性風險。期貨價格的走勢或會大幅波動。子基金未必適合所有投資者。閣下投資的價值可能全部歸零。
- 單位在聯交所的買賣價格視乎市場因素而定，可能以每單位資產淨值的大幅溢價／折價買賣。
- 基金經理可酌情從資本中作出派息。從資本中作出派息或實際上從資本中作出派息相當於從投資者原本的投資中或從原本的投資應佔的任何資本收益中收回或提取部分金額。任何涉及從子基金資本中作出派息或實際上從資本中作出派息的分派均可能令每單位資產淨值即時減少。

投資目標

子基金的投資目標為提供貼近美銀美林商品指數 eXtra CLA 指數（額外回報）（「指數」）表現的投資回 報（未扣除費用及開支）。

基金信息

法律結構	香港單位信託
管理人	南方東英資產管理有限公司
上市交易所	香港聯交所 – 主板
投資策略	全面複製策略
基金規模	878萬美元
已發行單位	8,400,000
基礎貨幣	美元
交易貨幣	港幣
派息頻率[4]	每年
基金受託人及過戶處	匯豐機構信託服務（亞洲）有限公司

參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
高盛(亞洲)證券有限公司
海通國際證券有限公司
Merrill Lynch Far East Limited
Morgan Stanley Hong Kong Securities Limited
野村國際(香港)有限公司

市場莊家

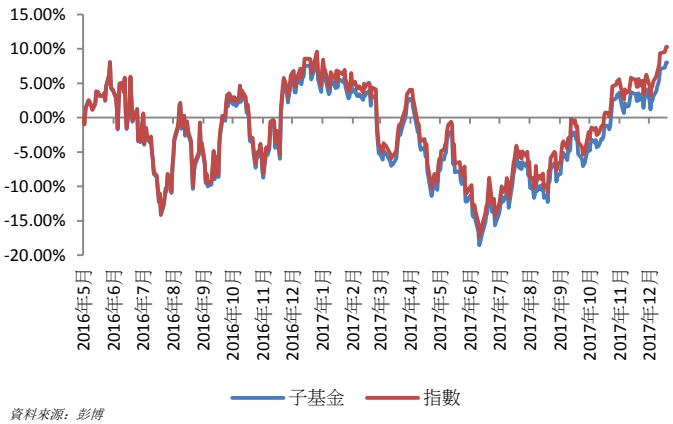
Bluefin HK Limited
Commerz Securities Hong Kong Limited

累積表現 (%)[1]

櫃檯	1個月	6個月	1年	3年	上市至今[3]
子基金	5.44	22.63	0.51	-	8.92
指數[2]	5.58	23.34	1.70	-	11.25

曆年表現 (%)[1]

櫃檯	2014	2015	2016[3]	今年至今[3]
子基金	-	-	8.37	0.51
指數[2]	-	-	9.39	1.70



資料來源：彭博

期貨合約詳情	數量
WTI CRUDE FUTURE Dec18	150

投資組合詳情	權重
現金及現金等價物(USD)	55.37%
TREASURY BILL TBILL 0.000 15 Mar 18	17.04%
TREASURY BILL TBILL 0.000 25 Jan 18	13.66%

股份類別信息

	淨值	上市日期	ISIN代碼	交易所代碼	彭博代碼	每手交易數量	管理費[5]	上次派息
美元	1.04	2016年5月12日	HK0000293818	3135	3135 HK Equity	100個單位	每年0.99%	-

註腳：

1. *基金表現根據基金單位資產淨值總回報計算，包括股息再投資。*
2. *基金的相關指數為美銀美林商品指數 eXtra CLA 指數（額外回報）（彭博代碼：MLCXCLAE Index），（「額外回報」並不代表子基金的表現會有任何額外的回報）。*
3. *自基金上市日2016年5月12日起計算。*
4. *派息全額（如有）可能由基金經理酌情決定。請參閱重要事項第五項。*
5. *全包管理費包括受託人費，託管費及過戶處費。*

南方東英資產管理有限公司；香港中環康樂廣場8號交易廣場二期2801-2803室
電話:(852) 3406-5688；網址：www.csopasset.com；電郵：investorservice@csopasset.com

南方東英 WTI 原油年度滾動十二月期貨 ER ETF

股份代號：3135

所有資料截至2017年12月31日

指數提供者免責聲明

Merrill Lynch、Pierce、Fenner & Smith Incorporated及其聯繫公司（「美銀美林」）之指數及相關資料，美銀美林之名稱及相關商標皆屬美銀美林許可使用的知識產權。任何人仕在未獲美銀美林書面許可的情況下不可復製、使用或分發有關資料。美銀美林並未就被許可人的產品是否合法及適當，亦沒有監管、發行、認可、銷售、保證或推廣有關產品。**美銀美林就指數及相關資料、商標及產品(包括但不限於產品之質素、準確性、適當性及完整性）並無作出任何保證，亦不會承擔任何責任。**

免責聲明

- 投資涉及風險。投資者應該在投資前細閱發行章程及產品資料概要以便獲得進一步的資料（包括其風險因素）。基金單位價值可升亦可跌，甚至有機會招致損失。過往的業績數據並不預示未來的業績表現。本公司對本基金的未來業績及資本值並無作出任何保證。投資者不應僅憑本材料而作出投資決定。

本資料未經證券及期貨事務監察委員會審閱。

發行者：南方東英資產管理有限公司